

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期:2014年3月26日  
§ 1 重要提示

1.1 重要提示  
基金管理人的董事、监事、高级管理人员在报告期内没有发生损害基金份额持有人利益的重大关联交易，且其内容的真伪性、准确性、完整性及合规性已分别由其本人或其配偶、直系亲属、主要负责人签署确认，并由基金管理人盖章。  
基金托管人:中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)，根据《基金法》及《基金合同》，于2014年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
基金经理对本基金过往业绩和代表未来表现的预测、投资决策、投资运作在报告前已经阅读并书面基金的招募说明书及其更新报告。  
本年度报告摘要于2014年3月26日登载于本公司网站。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	交银主题优选混合
基金简称	519700
交易代码	519700(前端) 519701(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年6月30日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	756,457,043.77份
基金合同存续期间	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过前程为主的主题挖掘，积极把握行业和个股投资机会，在控制风险并保持基金资产的流动性的情况下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
本基金主要投资于股票市场的股票型基金，属于中高风险品种。本产品的风险收益特征介于股票型基金和债券型基金之间。	本基金主要投资于股票市场的股票型基金，属于中高风险品种。本产品的风险收益特征介于股票型基金和债券型基金之间。
投资策略	本基金主要投资于股票市场的股票型基金，属于中高风险品种。本产品的风险收益特征介于股票型基金和债券型基金之间。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中债国债收益率

风险收益特征

本基金是一只只投资于股票型基金的基金，属于中高风险品种。本产品的风险收益特征介于股票型基金和债券型基金之间。

2.3 基金管理人和基金托管人

名称	基金管理人	基金托管人
交银施罗德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司	
联系人姓名	孙伟	田青
信息披露联系人电话	021-61055050	010-67599506
负责人电子邮箱	xplj@jzsf.com; disclosure@jzsf.com	tianq@bjcb.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000	010-67599506
传真	021-61055054	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址

www.fund001.com, www.hbcoschroder.com

基金年度报告备置地点

基金管理人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

	2013年	2012年末	2011年末
本期实现收益总额	-81,038,241.09	-97,061,085.79	-83,953,701.32
本期利润	-126,993,252.65	111,767,928.50	-305,475,729.99
加权平均基金份额本期利润	-0.1434	0.1005	-0.2982
本期基金份额净值增长率	-15.77%	14.46%	-27.15%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供基金份额利润	-0.220	-0.074	-0.191
期末基金份额净值	589,845,561.55	1,202,866,557.69	829,594,283.42
期末基金份额净值	0.780	0.926	0.809

注:1.本基金的报酬率不包括持有人认购或交易基金的各笔费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字;

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣减相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长 率(%)	份额净值增 长标准差(%)	业绩比较基 准收益率(%)	差额(%)	②-④
过去三个月	-0.76%	0.82%	-2.37%	0.68%	1.61%
过去六个月	3.59%	1.07%	3.40%	0.78%	0.29%
过去一年	-15.77%	1.24%	-3.46%	0.84%	-12.31%
成立以来	-29.76%	1.21%	-11.66%	0.80%	-18.10%
基金份额首次生 效日起至今	-20.91%	1.19%	-1.09%	0.82%	-19.82%
					0.37%

注:本基金的业绩比较基准为0%×沪深300指数收益率+40%×中债国债收益率,每日进行再平衡。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 近三年的基金的分红情况

单位:人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	-	-	-	-	-
2012年	-	-	-	-	-
2011年	0.150	10,840,840.75	5,770,881.70	16,611,722.45	-
合计	0.150	10,840,840.75	5,770,881.70	16,611,722.45	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人对基金年度报告的评价意见

4.2 管理人报告期内本基金运作合规的说明

4.3 报告期内基金组合类产品的评价

4.4 报告期内基金的税收情况

4.5 报告期内管理费率、托管费率的变动情况

4.6 报告期内管理费率、托管费率的变动原因说明

4.7 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金份额净值的影响

4.8 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.9 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金份额净值的影响

4.10 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.11 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.12 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.13 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.14 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.15 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.16 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.17 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.18 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.19 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.20 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.21 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.22 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.23 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.24 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.25 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.26 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.27 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.28 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.29 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.30 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.31 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.32 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.33 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.34 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.35 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.36 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.37 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.38 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.39 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.40 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.41 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.42 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.43 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.44 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.45 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.46 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.47 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.48 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.49 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.50 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.51 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.52 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.53 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.54 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响

4.55 报告期内管理费率、托管费率的变动对基金收益的影响